

Central Daily Market Report

2017年1月12日(木)
セントラル短資株式会社 総合企画部

●資金需給

単位：億円	2017年1月12日		2017年1月13日		2017年1月16日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	3,000		1,900		3,000	
財政	▲ 9,300		▲ 7,000		▲ 31,000	
資金過不足	▲ 6,300		▲ 5,100		▲ 28,000	
金融調節	スタート	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
貸出						
全店共通					1,600	▲ 1,500
国債買現						
国庫短期証買入	17,500					
国債買入	8,600				7,100	
CP等買入	2,500	▲ 300		▲ 400		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						
ETF買入			100			
国債補完供給	▲ 200	200		200		
当預増減	22,000		▲ 5,200		▲ 20,800	
当座預金残高	3,314,800		3,309,600		3,288,800	
準備預金残高	2,972,400					
積み終了先	2,494,500				1月13日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,494,500				積数	100
非準備預金先	342,400				1日平均	0
積み期間(12/16~1/15)の所要準備額						2,222,400
準備預金進捗率	実績	100.00%	日数	90.32%		

●2017年1月12日の市場動向

<インターバンク市場>

午前8時発表の準備預金残高見込みは、前日比9,000億円増加の249兆8,000億円(当座預金残高見込みは331兆5,000億円)。本日の無担O/N物は、都銀・信託・証券業態などから▲0.04~▲0.03%、地銀業態から▲0.04~▲0.03%近辺の調達希望で始まった。実質的な積み最終日を翌日に控えている影響で各業態の調達意欲は旺盛で、朝方は▲0.02%台での出会いが中心。一巡後は徐々に取り下がり、▲0.05~▲0.03%の幅広いレンジで出会いが見られた。ターム物は、閑散な地合いであった。

<レポ市場>

GC T/N(1/13-1/16)は、▲0.10~▲0.09%程度のお合い。S/N(1/16-1/17)は、▲0.095~▲0.09%程度のお合い。S/Nは新積み期に入り、投資家からの資金調達は減少した。SCは、個別銘柄では、5y126、5y128~130、10y330、333、340~345、20y159、30y52、40y9などにビッドが多く見られた。

<短国市場>

現先レートは横ばい圏で推移。アウトライト市場は3M物の入札が実施された。結果は平均落札利回▲0.3086%、按分落札利回▲0.2685%と償還日が欧州の休日にあたることで嫌気されたのか、WI取引の▲0.34~▲0.335%という出会いを大きく上回り、按分レートが流れた。セカンダリーは▲0.275%で出会いが見られた程度であった。

<CP市場>

現先レートは横ばい圏で推移。発行市場は15日の後倒し発行も見られ、機械、商社、自動車業態等からまとまった発行が見られ総額2,100億円程度に膨らんだ。発行レートは概ね0%近辺で推移した。

●短期金融市場関連指標

2017/1/12	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京レポレート	JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
	単位：%	最低	最高	平均	最低	最高			平均	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)
O/N	▲ 0.070	0.001	▲ 0.027				-	▲ 0.087	0.040	▲ 0.015	19,134.70	▲ 229.97	115.09-11	114.30-32
T/N							-	▲ 0.095						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.035	0.230	0.005				-	▲ 0.097						
2W							-	▲ 0.099						
3W			▲ 0.020				-	▲ 0.102						
1M			0.000				-	▲ 0.106						
3M							▲ 0.264	▲ 0.154						
6M							▲ 0.434	▲ 0.225						
1Y							▲ 0.301	▲ 0.228						
									日付	1/4	1/5	1/6	1/10	1/11
									日銀当預残	3,328,300	3,331,300	3,328,100	3,296,800	3,292,800
									準備預金残	2,996,000	3,002,500	3,000,400	2,974,200	2,969,800
									マネタリーベース	4,394,800	4,393,500	4,386,600	4,351,000	4,342,700
									無担O/N加重平均	▲0.051%	▲0.047%	▲0.042%	▲0.037%	▲0.030%
									コール市場残高	91,677	96,692	102,586	101,413	100,845
									うち無担	72,944	77,073	82,019	81,164	79,913
									うちO/N	47,804	50,313	52,659	52,544	51,773
									うち有担	18,733	19,619	20,567	20,249	20,932

●入札結果

名称	回号	表面利率	発行予定額	発行日	償還日	応募額(億円)	募入額(億円)	募入最低額	募入最高利回・利回較差	素分率	募入平均価格	募入平均利回・利回較差	第1非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	657	-	44,200	2017/1/16	2017/4/17	112,214.0	40,390.00	100.0670	▲0.2685%	19.2000%	100.0770	▲0.3086%	3,810.0

●オペ結果

種類	オファー額(億円・百万ドル)	スタート日	エンド日	貸付利率	応札総額(億円・百万ドル)	落札総額(億円・百万ドル)	按分レート・利回較差・価格較差	全取レート・利回較差・価格較差	平均落札レート・利回較差・価格較差	按分比率
共通担保資金供給(全店)<固定金利方式>	8,000	2017/1/16	2017/1/30		1,411	1,411				
共通担保資金供給(全店)<固定金利方式>	5,000	2017/1/16	2017/4/24		210	210				
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,100	2017/1/16			11,298	4,108	▲0.008		▲0.006	46.6
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,900	2017/1/16			4,799	1,904	0.000		0.000	80.8
国債買入(残存期間25年超)	1,100	2017/1/16			3,356	1,102	▲0.007		▲0.005	95.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	60,986	2017/1/12	2017/1/13		191	191		▲0.500	▲0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	9,970	2017/1/12	2017/1/13		12	12		▲0.600	▲0.600	

●2017年1月13日の予定

*11月の特定サービス産業動態統計速報	*米国11月の企業在庫	*流動性供給入札(2,000億円、1/17発行)
*12月のマネーストック	*米国12月の生産者物価指数	*交付税特別会計借入(10,500億円、1/23借入)
	*米国12月の小売売上高	
	*米国1月のミシガン大学消費者信頼感指数速報	

◆本資料は信頼できると思われる各種データに基づいて作成されておりますが、当社はその正確性、完全性を保証するものではありません。

◆本資料は何かの取引を誘引することを目的としたものではありません。売買に関する最終判断はお客様ご自身でなされますようお願い申し上げます。

◆金融商品のお取引には価格変動等によるリスクがあります。金融商品のお取引には手数料等をご負担頂くものがあります。金融商品取引法に基づきお渡しする書面や目録見書をよくお読みください。

セントラル短資株式会社 登録金融機関関東財務局長(登金)第526号 日本証券業協会加入